(上接B2版)

本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调收益的安全性与稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的较高收益。

(1)自上而下的整体资产配置策略

本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置,通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征,进而在债券类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2)自上而下的类属资产配置策略

本基金在整体资产配置策略的框架下,根据类属资产的收益率水平、风险来源、市场流动性、利息税务处理等因素,采取积极的投资策略,定期对投资组合类属资产进行优化配置,以寻求收益、风险、流动性之间的最佳平衡点。针对固定收益类资产,本基金将市场细分为可转债(含传统可转债、分离交易可转债等)、普通债券(含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券等)、资产证券化产品三个子市场,其中可转债根据其市场转换溢价率及其价格相对标的股票价格的变动情况,将进一步划分为偏股型、平衡型和偏债型进行优化配置。

(3)自下而上的明细资产配置策略

本基金采取自下而上的方法挑选个券和个股。在个券选择方面,本基金将债券的估值水平、剩余期限、正股基本面、信用风险程度等作为个券是否能够纳入投资组合的主要考量指标;同时对照本基金的收益要求,进一步考虑正股基本面与可转债估值水平的配比、普通债券的收益率与剩余期限的配比等因素;并且根据个券的流动性指标决定投资总量。在个股选择方面,本基金将采用定性分析与定量分析相结合的方式精选行业地位领先、成长前景向好、估值具有优势的优质品种。

① 固定收益类产品投资策略

I.可转债投资策略

本基金将积极参与发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的可转债的一级市场申购,上市后根据个券的具体情况做出持有或卖出的决策;同时,本基金将综合运用多种可转债投资策略进行二级市场投资操作,在承担较小风险的前提下获取较高的投资回报。

(i)传统可转债投资策略

传统可转债即指可转换公司债券,其投资者可以在约定的期限内按照事先确定的价格将该债券转换为公司普通股。可转换公司债券同时具备了普通股所不具备的债性和普通债券不具备的股性。当标的股票下跌时,可转换公司债券的价格可以受到债券价值的支撑;当标的股票上涨时,可转换公司债券内含的期权使其可以分享股价上涨带来的收益。可转换公司债券的理论价值应该等于作为普通公司债券的基础价值加上内含的转股期权价值。

? 个券精选策略。本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究,采用定性分析(行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等)与定量分析(P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV等)相结合的方式精选成长性好且估值合理的正股,同时考虑证券市场的环境,并在对应可转债估值合理的前提下集中投资,以分享正股上涨带来的收益。

? 买入并持有策略。与股票市场类似,可转债市场存在着周期性的起伏波动。当股票市场持续下跌时,投资者容易过度悲观,可转债的期权价值可能被市场低估,表现为可转债的债券溢价率很低。本基金将在信用风险可控的前提下,买入债券溢价率较低的可转债,并坚持长期持有,以获取低风险稳定回报。

? 条款博弈策略。通常情况下,可转债均设有一些特殊条款,如修正条款、回售条款、赎回条款等。修正条款给予发行人向下修正转股价格的权利,有利于提升可转债的期权价值,对投资者是一种保护条款,有时甚至能直接推动可转债价格的上涨;回售条款给予投资者将可转债回售给发行人的权利,对于投资者有保护作用,回售价格是判断可转债安全边际的重要因素之一;赎回条款给予发行人从投资者处赎回可转债的权利,如发行人放弃赎回权则会提高可转债的期权价值。本基金将充分发掘各项条款博弈给可转债带来的投资机会。

? 低风险套利策略。由于可转债可以按照约定的价格转换为股票,因此在日常交易过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当可转债的转换溢价率为负时,买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差;反之,买入标的股票的同时卖出可转债也可以获得套利价差。当对可转债未来的转换溢价率有比较明确的趋势判断时,该种套利策略同样适用。在日常交易过程中,本基金将密切关注可转债与标的股票之间的对比关系,恰当的选择时机进行套利,以增强基金资产组合的收益。

? 分阶段投资策略。在可转债发行和存续的各个阶段,由于品种本身的特征和属性,可转债的走势随市场环境会呈现出与股票市场正相关或相对独立的规律,它在大概率上适用于所有可转债,仅在少数情况下受可转债的个性影响而不适用。本基金将充分利用可转债各个阶段的特征,并结合个券的具体情况,适时运用分阶段投资策略。

(ii)分离交易可转债投资策略

分离交易可转债即指认股权和债券分离交易的可转换公司债券,它是一种附认股权证的公司债,上市后可分离为纯债和认股权证两部分。分离交易可转债是债券和股票的混合融资品种,它与传统可转债的本质区别在于上市后债券与期权将各自单独交易。尽管如此,分离交易后的纯债和认股权证组合在一起仍然具有传统可转债的部分特征,甚至分离交易可转债的纯债和标的股票组合在一起也可以构造出类可转债品种,因为实践证明,不论是认股权证还是标的股票,与传统可转债内含的期权之间都具有很强的相关性。

分离交易可转债可以采取与传统可转债类似的投资策略。此外,也可以通过调整纯债和认股权证或标的股票之间的比例来组合成不同风险收益特征的类可转债产品,从而应对不同的市场环境。本基金将对纯债和认股权证或标的股票之间的最佳比例进行量化研究,并适时进行动态调整。

II.普通债券投资策略

本基金主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,在对普通债券的投资过程中,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。

(i)久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效控制整体资产风险。

(ii)期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(iii)信用风险控制是基金管理人充分利用现有行业与公司研究力量,根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估,以此作为品种选择的基本依据。

(iv)跨市场套利是根据不同债券市场间的运行规律和风险特性,构建和调整债券资产组合,提高投资收益,实现跨市场套利。

(v)相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上涨的债券,减持相对高估、价格将下跌的债券。

此外,对于内嵌赎回或回售选择权的债券,本基金将利用债券市场收益率数据,运用利率模型,计算含赎回或回售选择权的债券的期权调整利差(OAS),作为此类债券投资决策的主要依据。

III.资产证券化产品投资策略

资产证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产,通过一定的结构化安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。

本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产证券化产品。

② 股票投资策略

I.二级市场股票投资策略

本基金可以直接参与二级市场投资的品种仅限于与可转债相关的股票, 包括传统可转债对应的标的股票、分离交易可转债发行人发行的股票。

自上市公司公告董事会通过可转债发行议案之日起,该股票可进入本基金股票库;自可转债摘牌日或上市公司公告取消可转债议案之日起,本基金必须在60个交易日内卖出对应股票。

本基金参与二级市场的股票投资与可转债的研究和投资紧密相联,重点投资于行业地位领先、成长前景向好、估值具有优势的股票品种,以及有利于可转债套利、纯债和标的股票构造类可转债组合等投资策略的执行的股票品种。

此外,本基金将充分利用标的股票在可转债发行及存续的各个阶段呈现出的不同特征,积极参与标的股票在各个阶段的投资机会。

在个股选择过程中,本基金主要采取自下而上的投资策略,借鉴国外的投资管理经验,结合国内市场的特征,采用基本面研究与数量化分析相结合的方法,对以下三类上市公司进行重点投资:

(i)现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红纪录或现金分红潜力的优质上市公司;

(ii)投资价值明显被市场低估的上市公司;

(iii)未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。

II.一级市场新股申购策略

本基金将深入研究首次公开发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,挖掘公司的内在价值,根据当时股票市场整体投资环境及定价水平,发行折价水平及一、二级市场间资金供求关系,在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。对通过新股申购获得的股票,本基金将在其上市流通之日起60个交易日内卖出。

③ 权证投资策略

在确保与基金投资目标一致以及风险可控的前提下,本基金可适度进行谨慎的权证投资。基金对权证投资的目标首先是与纯债组合构造类可转债产品,其次是谋求基金资产的稳定增值。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准=天相转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中风险较低的品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

十一、基金的投资组合报告

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	191,606,651.18	6.86
	其中:股票	191,606,651.18	6.86
2	固定收益投资	2,550,437,064.14	91.32
	其中:债券	2,550,437,064.14	91.32
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	29,083,704.19	1.04
6	其他资产	21,732,397.69	0.78
7	合计	2,792,859,817.20	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	11,883,880.94	0.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	8,535,014.40	0.49
F	批发和零售业	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	44,253.44	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	154,211,862.40	8.78
K	房地产业	16,931,640.00	0.96
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	191,606,651.18	10.91

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	9,725,675	92,977,453.00	5.29
2	600109	国金证券	4,769,035	61,234,409.40	3.49
3	600185	格力地产	2,222,000	16,931,640.00	0.96
4	600362	江西铜业	734,026	11,883,880.94	0.68
5	600820	隧道股份	969,888	8,535,014.40	0.49
6	600026	中海发展	9,878	44,253.44	0.00

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	89,758,000.00	5.11
	其中:政策性金融债	89,758,000.00	5.11
4	企业债券	291,015,087.95	16.57
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	2,169,663,976.19	123.52
8	其他	–	–
9	合计	2,550,437,064.14	145.20

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	5,296,250	529,783,887.50	30.16
2	110023	民生转债	4,436,990	469,477,911.90	26.73
3	113002	工行转债	3,516,110	389,690,471.30	22.18
4	110015	石化转债	2,962,000	289,950,180.00	16.51
5	113003	重工转债	1,019,200	129,581,088.00	7.38

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

(3)本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

10、投资组合报告附注

(1)申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

(2)申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	738,766.77
2	应收证券清算款	3,568,630.19
3	应收股利	–
4	应收利息	17,402,382.71
5	应收申购款	22,618.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	21,732,397.69

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	529,783,887.50	30.16
2	110023	民生转债	469,477,911.90	26.73
3	113002	工行转债	389,690,471.30	22.18
4	110015	石化转债	289,950,180.00	16.51
5	113003	重工转债	129,581,088.00	7.38
6	110020	南山转债	82,152,780.00	4.68
7	110018	国电转债	73,801,637.00	4.20
8	110017	中海转债	49,040,846.80	2.79
9	110016	川投转债	34,295,027.00	1.95
10	125089	深机转债	25,112,946.74	1.43
11	110011	歌华转债	22,908,503.70	1.30
12	110022	同仁转债	18,711,000.00	1.07
13	110007	博汇转债	13,168,925.50	0.75
14	127001	海直转债	9,951,881.22	0.57
15	110012	海运转债	9,523,500.00	0.54
16	110019	恒丰转债	6,624,032.80	0.38
17	128001	泰尔转债	6,318,397.69	0.36
18	125887	中鼎转债	6,317,508.40	0.36

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、富国可转换债券证券投资基金历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011.1.1-2011.12.31	-11.43%	0.56%	-12.32%	0.56%	0.89%	0.00%
2012.1.1-2012.12.31	1.70%	0.43%	4.60%	0.44%	-2.90%	-0.01%
2013.1.1-2013.6.30	-0.33%	0.75%	-0.97%	0.72%	0.64%	0.03%
2013.1.1-2013.9.30	-1.11%	0.70%	1.86%	0.67%	-2.97%	0.03%
2010.12.8-2013.9.30	-11.20%	0.55%	-7.70%	0.55%	-3.50%	0.00%

2、自基金合同生效以来富国可转换债券证券投资基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:1.截止日期为2013年9月30日。

2.本基金于2010年12月8日成立,建仓期自2010年12月8日至2011年6月7日共6个月,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用列示

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金合同生效后的信息披露费用;

(4)基金份额持有人大会费用;

(5)基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费;

(6)基金的证券交易费用;

(7)基金财产拨划支付的银行费用;

(8)按照国家有关规定和基金合同约定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.7%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.2%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

(3)上述(一)中3到7项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

4、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率, 无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费用,投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。

(1)投资者选择交纳前端申购费用时,按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。本基金前端申购对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

具体费率如下:

A、前端申购费率:

申购金额(含申购费)	前端申购费率
100万元以下	0.8%
100万元(含)—500万元	0.5%
500万元(含)以上	1000元/笔

注:上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的选择前端收费模式申购本基金的基金份额投资者。

B、特定申购费率:

申购金额(含申购费)	特定申购费率
100万元以下	0.24%
100万元(含)—500万元	0.15%
500万元(含)以上	1000元/笔

注:上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台、选择前端收费模式申购本基金基金份额的养老金客户,包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:全国社会保障基金;可以投资基金的地方社会保障基金;企业年金单一计划以及集合计划;企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

(2)投资者选择交纳后端申购费用时,按申购金额采用比例费率,费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	后端申购费率
1年以内(含)	1.0%
1年—3年(含)	0.6%
3年—5年(含)	0.4%
5年以上	0

2、赎回费率

本基金赎回费用由基金赎回人承担,赎回费用的25%归基金财产,其余用于支付市场推广、注册登记费和其他必要的手续费。赎回费率按持有时间递减,具体费率如下:

持有时间	赎回费率
1年以内(含)	0.1%
1年-2年(含)	0.05%
2年以上	0

基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露管理办法》的有关规定,在至少一家指定报刊及基金管理人网站公告。

3、转换费

(1)前端转前端

基金转换费用由转出基金的赎回费和转出和转入基金的申购费补差两部分构成, 具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。其中: 转出基金赎回费是按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用; 转入基金申购补差费是按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。对于前端转前端模式,转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的,补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额;转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的,补差费为零。基金转换的计算公式如下:

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入金额=转出金额-转出基金赎回费

净转入金额=转入金额÷(1+申购补差费率)

申购补差费=转入金额-净转入金额

转入份额=净转入金额÷转入基金当日之基金份额净值

注:转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金,且全部份额转出账户时,则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

(2)后端转后端

后端收费模式基金发生转换时,其转换费由转出基金的赎回费和申购补差费两部分构成,其中申购补差费率按照转入基金与转出基金的后端申购费率的差额计算。当转出基金后端申购费率高于转入基金后端申购费率时,基金转换申购费补差费率为转出基金与转入基金申购费率之差;当转出基金的后端申购费率低于转入基金的后端申购费率,申购补差费率为零。

(2.1)对于由中国证券登记结算有限责任公司担任注册登记机构的基金,其后端收费模式下份额之间互相转换的计算公式如下:

转出金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费用=(转出金额-转出基金赎回费用)×补差费率

净转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费用

转入份额=净转入金额/转换申请当日转入基金的基金份额净值

(2.2)对于由本公司担任注册登记机构的基金,后端收费模式下基金份额之间互相转换的计算公式如下:

转出金额=转出份额×转换申请当日转出基金的基金份额净值

转出基金赎回费用=转出金额×转出基金赎回费率

申购补差费=(转出金额-转出基金赎回费用)×补差费率/(1+补差费率)

净转入金额=转出金额-转出基金赎回费用-申购补差费用

转入份额=净转入金额/转换申请当日转入基金的基金份额净值

注:转换份额的计算结果保留到小数点后2位。如转出基金为货币基金,且全部份额转出账户时,则净转入金额应加上转出货币基金的当前累计未付收益。

基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一注册登记人处注册登记的、同一收费模式的开放式基金。

对于养老金客户基金转换, 如在实施特定申购费率的基金间转换, 则按特定申购费率之间的价差进行补差,如转换的两只基金中至少有一支为非实施特定申购费率的基金,则按照原申购费率之间的价差进行补差。详见本公司2013年2月7日公告《富国基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率的公告》。

(三)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、"重要提示" 部分更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、"三、基金管理人" 部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

3、"四、基金托管人" 部分对主要人员情况、基金托管业务经营情况等内容进行了更新。

4、"五、相关服务机构" 部分对基金销售机构进行了更新。

5、"八、基金份额的申购、赎回与转换" 部分对本基金申购和赎回的场所、申购和赎回的数额限定、申购和赎回的数额和价格、基金转换进行了更新。

6、"九、基金的投资" 部分将基金投资组合报告更新至2013年9月30日。

7、"十、基金的业绩" 部分对基金业绩更新至2013年9月30日,并更新了历史走势对比图。

8、"十七、风险揭示" 部分在声明中对本基金的代销机构进行了更新。

9、"二十、托管协议的内容摘要" 部分更新了基金托管人的经营范围。

10、"二十一、对基金份额持有人的服务" 部分更新了基金份额持有人交易资料的寄送服务。

11、"二十二、其他应披露事项" 部分对本报告期内的应披露事项予以更新。

富国基金管理有限公司
二〇一四年一月十四日

证券简称:中粮生化　　证券代码:000930　　公告编号:2014-002

中粮生物化学(安徽)股份有限公司关于监事会换届选举的公告

本公司及监事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中粮生物化学(安徽)股份有限公司(以下简称"中粮生化"或"本公司")第五届监事会任期将于2014年1月19日届满。为了顺利完成监事会的换届选举(以下简称"本次换届选举"),本公司监事会依据《公司法》、《公司章程》的相关规定,将第六届监事会的组成、监事候选人的推荐、本次换届选举的程序、监事候选人任职资格等公告如下:

一、第六届监事会的组成

根据本公司现行《公司章程》的规定,第六届监事会由3名监事组成,其中职工代表出任的监事1名,监事任期自相关股东大会选举通过之日起计算,任期三年。

二、监事候选人的推荐(监事候选人推荐书见附件)

(一)股东推荐的监事候选人

本公司监事会及本公告发布之日单独或者合并持有公司发行在外有表决权股份总数的5%以上 (含5%)的股东有权向第五届监事会书面提名推荐第六届监事会监事候选人。

(二)职工代表担任的监事的产生

职工代表担任的监事由公司职工代表民主选举产生。

三、本次换届选举的程序

1、推荐人在本公告发布之日起10日内按本公告约定的方式向本公司监事会推荐监事候选人并提交相关文件。

2、推荐期满后,公司监事会不再接收各方的监事候选人推荐;公司监事会召开会议,对推荐的监事候选人进行资格审查,确定监事候选人名单,并以提案的方式提请公司相关股东大会审议。

3、监事候选人应在股东大会召开之前作出声明书面承诺,同意接受提名,并承诺资料真实、完整并保证当选后履行监事职责。

4、经股东大会选举产生的监事与经本公司职工代表民主选举产生的职工监事共同组成公司第六届监事会。

四、监事任职资格

根据《公司法》和《公司章程》及有关法律法规的规定,本公司监事候选人应须具有法律、财务、会计等方面的专业知识、具备与担任监事相适应的工作阅历和工作经验。凡具有下述条款所述事实者不能担任本公司监事:

1、无民事行为能力或者限制民事行为能力;

2、因犯有贪污、贿赂、侵占财产、挪用财产罪或者破坏社会主义社会经济秩序罪,被判处刑罚,执行期满未逾五年,或者因犯罪被剥夺政治权利,执行期满未逾五年;

3、担任因经营不善破产清算的公司、企业的监事或者厂长、经理,并对该公司的破产负有个人责任的,自该公司、企业破产清算完结之日起未逾三年;

4、担任因违法被吊销营业执照的公司、企业的法定代表人,并负有个人责任的,自该公司、企业被吊销执照之日起未逾三年;

5、个人所负数额较大的债务到期未清偿;

6、被中国证监会处以证券市场禁入处罚,期限未满的;

7、国家公务员或担任公司监事违反《公务员法》相关规定的;

8、本公司董事、高级管理人员;

9、法律、行政法规或部门规章规定的其他内容。

五、关于推荐人应提供的相关文件说明

1、推荐人推荐监事候选人,必须向本公司监事会提供下列文件:

(1)监事候选人推荐书(原件);

(2)推荐的监事候选人的身份证明复印件(原件备查);

(3)推荐的监事候选人的履历表、学历、学位证书复印件(原件备查);

(4)能证明符合本公告规定条件的其他文件。

2、若推荐人为本公司股东,则该推荐人应同时提供下列文件:

(1)如果是个人股东,则需提供其身份证明复印件(原件备查);

(2)如是法人股东,则需提供其营业执照复印件(原件备查);

(3)股票账户卡复印件(原件备查);

(4)本公告发布之日的持股凭证。

3、推荐人向本公司监事会推荐监事候选人方式如下:

(1)本次推荐方式仅限于亲自送达或邮寄两种方式;

(2) 如采取亲自送达的方式, 则推荐人应在推荐期内将相关文件送达至本公司指定联系人处方为有效;

(3)如采取邮寄方式,则推荐人应在推荐期内将相关文件传真至0552-4926758,并经指定联系人确定收到;同时,"监事候选人推荐书" 的原件及其他相关文件应在推荐期内(以邮戳时间为准)邮寄至本公司指定联系人处方为有效。

六、联系方式

联系人:孙淑媛　崔伟
联系部门:公司董事会办公室
联系电话:0552-4926909
联系传真:0552-4926758
联系地址:安徽省蚌埠市中粮大道1号 董事会办公室
邮政编码:233010

特此公告。

中粮生物化学(安徽)股份有限公司
监 事 会
2014年1月13日

中粮生物化学(安徽)股份有限公司
第六届监事会监事候选人推荐书

推荐人			推荐人 联系电话		
推荐的监事候选人信息					
姓名		年龄		性别	
电话		传真		电子邮箱	
任职资格:是否符合本公告规定的条件					
简历(包括学历、职称、工作履历等情况)					
被推荐人与推荐人关系					
其他说明(如有,见注)					
推荐人:(签名/盖章) 二〇一四年　月　日					

注:应说明推荐的候选人与持有公司百分之五以上股份的股东、实际控制人之间的关系、其最近五年在其他机构担任董事、监事、高级管理人员的情况、其持有上市公司股份数量、其是否受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒等。

证券简称:中粮生化　　证券代码:000930　　公告编号:2014-001

中粮生物化学(安徽)股份有限公司关于董事会换届选举的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中粮生物化学(安徽)股份有限公司(以下简称"中粮生化"或"本公司")第五届董事会任期将于2014年1月19日届满。为了顺利完成董事会的换届选举(以下简称"本次换届选举"),本公司董事会依据《公司法》、《公司章程》、《中粮生化董事会提名委员会工作细则》的相关规定,将第六届董事会的组成、董事候选人的推荐、本次换届选举的程序、董事候选人任职资格等公告如下:

一、第六届董事会的组成

根据本公司现行《公司章程》的规定,第六届董事会由9名董事组成,其中独立董事3名,董事任期自相关股东大会选举通过之日起计算,任期三年。

二、董事候选人的推荐(董事候选人推荐书见附件)

(三)非独立董事候选人的推荐

本公司董事会及本公告发布之日单独或者合并持有公司发行在外有表决权股份总数的5%以上 (含5%)的股东有权向第五届董事会书面提名推荐第六届董事会非独立董事候选人。

(四)独立董事候选人的推荐

本公司董事会、监事会及本公告发布之日单独或者合并持有公司发行在外有表决权股份总数的1%以上(含1%)的股东有权向第五届董事会书面提名推荐第六届董事会独立董事候选人。

三、本次换届选举的程序

1、推荐人在本公告发布之日起10日内按本公告约定的方式向本公司董事会推荐董事候选人并提交相关文件。董事会提名委员会同时在本公司内及人才市场等搜寻董事人选。

2、推荐期满后,公司董事会不再接收各方的董事候选人推荐;公司董事会提名委员会对推荐的董事候选人及其自行搜寻的董事人选进行资格审查,对于符合任职资格的董事候选人,将提交本公司董事会。

3、公司董事会根据董事会提名委员会提交的人选召开董事会确定董事候选人名单,并以提案的方式提请本公司股东大会审议。

4、董事候选人应在股东大会召开之前作出声明书面承诺,同意接受提名,并承诺资料真实、完整并保证当选后履行董事职责;独立董事候选人亦应依法作出相关声明。

5、公司在不迟于发布召开关于选举独立董事的股东大会通知时,将独立董事候选人的有关材料(包括但不限于提名人声明、候选人声明、独立董事履历表)报送深圳证券交易所进行审核。

四、董事任职资格

(一)非独立董事任职资格

根据《公司法》和《公司章程》及有关法律法规的规定,本公司董事候选人应为自然人,凡具有下述条款所述事实者不能担任本公司董事:

1、无民事行为能力或者限制民事行为能力;

2、因犯有贪污、贿赂、侵占财产、挪用财产罪或者破坏社会主义社会经济秩序罪,被判处刑罚,执行期满未逾五年,或者因犯罪被剥夺政治权利,执行期满未逾五年;

3、担任因经营不善破产清算的公司、企业的董事或者厂长、经理,并对该公司的破产负有个人责任的,自该公司、企业破产清算完结之日起未逾三年;

4、担任因违法被吊销营业执照的公司、企业的法定代表人,并负有个人责任的,自该公司、企业被吊销执照之日起未逾三年;

5、个人所负数额较大的债务到期未清偿;

6、被中国证监会处以证券市场禁入处罚,期限未满的;

7、国家公务员或担任公司董事违反《公务员法》相关规定的;

8、法律、行政法规或部门规章规定的其他内容。

(二)独立董事任职资格

本公司独立董事候选人除需具备上述任职资格之外,还必须满足下述条款所述事实:

1、具备上市公司运作的基本知识,熟悉相关法律、行政法规、规章及规则,并确保有足够的时间和精力履行其职责;

2、具有五年以上法律、经济或其他履行独立董事职责所必需的工作经验;

3、通过中国证监会或证券交易所的独立董事培训并获得培训证书;

4、《公司章程》规定的其他条件;

5、具有下列情形之一的,不得担任本公司的独立董事:

(1)在公司或者附属企业任职的人员及其直系亲属、主要社会关系(直系亲属是指配偶、父母、子女等;主要社会关系是指兄弟姐妹、岳父母、儿媳女婿、兄弟姐妹的配偶、配偶的兄弟姐妹等);

(2)直接或间接持有公司已发行股份1%以上或者是公司前十名股东中的自然人股东及其直系亲属;

(3) 在直接或间接持有公司已发行股份5%以上的股东单位或者在公司前五名股东单位任职的人员及其直系亲属;

(4)最近一年内曾经具有前三项所列举情形的人员;

(5)为公司或者其附属企业提供财务、法律、咨询等服务的人员;

(6)已在五家(含五家)上市公司担任独立董事职务的人员;

(7)中国证监会认定的其他人员。

五、关于推荐人应提供的相关文件说明

1、推荐人推荐董事候选人,必须向本公司董事会提供下列文件:

(1)董事候选人推荐书(原件);

(2)推荐的董事候选人的身份证明复印件(原件备查);

(3)推荐的董事候选人的履历表、学历、学位证书复印件(原件备查);

(4) 如推荐独立董事候选人,则需提供独立董事培训证书复印件(原件备查);

(5)能证明符合本公告规定条件的其他文件。

2、若推荐人为本公司股东,则该推荐人应同时提供下列文件:

(1)如果是个人股东,则需提供其身份证明复印件(原件备查);

(2)如是法人股东,则需提供其营业执照复印件(原件备查);

(3)股票账户卡复印件(原件备查);

(4)本公告发布之日的持股凭证。

3、推荐人向本公司董事会推荐董事候选人方式如下:

(1)本次推荐方式仅限于亲自送达或邮寄两种方式;

(2) 如采取亲自送达的方式, 则推荐人应在推荐期内将相关文件送达至本公司指定联系人处方为有效;

(3)如采取邮寄方式,则推荐人应在推荐期内将相关文件传真至0552-4926758,并经指定联系人确定收到;同时,"董事候选人推荐书" 的原件及其他相关文件应在推荐期内(以邮戳时间为准)邮寄至本公司指定联系人处方为有效。

六、联系方式

联系人: 孙淑媛　崔伟
联系部门:公司董事会办公室
联系电话:0552-4926909
联系传真:0552-4926758
联系地址:安徽省蚌埠市中粮大道1号 董事会办公室
邮政编码:233010

特此公告。

中粮生物化学(安徽)股份有限公司
董 事 会
2014年1月13日

中粮生物化学(安徽)股份有限公司
第六届董事会董事候选人推荐书

推荐人			推荐人 联系电话		
推荐的候选人类别	□非独立董事□独立董事(请在推荐的董事类别前打"√")				
推荐的董事候选人信息					
姓名		年龄		性别	
电话		传真		电子邮箱	
任职资格:是否符合本公告规定的条件					
简历(包括学历、职称、工作履历等情况)					
被推荐人与推荐人关系					
其他说明(如有,见注)					
推荐人:(签名/盖章) 二〇一四年　月　日					

注:应说明推荐的候选人与持有公司百分之五以上股份的股东、实际控制人之间的关系、其最近五年在其他机构担任董事、监事、高级管理人员的情况、其持有上市公司股份数量、其是否受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒等。

证券代码:600648,900912　　证券简称:外高桥、外高B股　　编号:临2014-001

上海外高桥保税区开发股份有限公司关于收购上海外高桥物流开发有限公司36.67%股权的进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

重要内容提示:

- 公司控股股东上海外高桥(集团)有限公司(以下简称"外高桥集团")将其所持有的上海外高桥物流开发有限公司(以下简称"物流开发公司")36.67%的股权进行公开挂牌,公司子公司上海市外高桥保税区三联发展有限公司(以下简称"三联发公司")以54,025,408.29元的价格摘得该36.67%的股权。

公司第七届董事会第二十三次会议审议通过了关于收购上海外高桥物流开发有限公司36.67%股权事宜。审议议案时关联董事(舒榕斌、施伟民、李云章、陈卫星、姚忠)回避表决。独立董事对本次交易的独立意见见上海证券交易所网站公告(公告日2013年10月1日)。

- 本次交易未构成重大资产重组。
- 本次交易实施不存在重大法律障碍。
- 本次交易已于近日完成产权交割,尚未办理工商变更登记。

一、交易概述

外高桥集团将其所持有的物流开发公司36.67%的股权进行公开挂牌。近日,公司子公司三联发公司以54,025,408.29元的价格摘得物流开发公司36.67%的股权。

二、交易双方介绍

1、资产出让方:外高桥集团

注册资本: 1,255,507,648元人民币

注册地址: 上海市富特西一路159号

法定代表人:舒榕斌

主营业务:对国有资产经营管理、实业投资、区内房地产开发经营、国内贸易(除专项规定)、区内贸易、外商投资项目咨询、保税区与境外之间的贸易。

2、资产受让方:三联发公司

注册资本:324,923,040元人民币

注册地址:上海市外高桥保税区杨高北路2001号

法定代表人:姚忠

主营业务:负责外高桥保税区及其配套区域的开发、经营及工程承包,建筑设计、物资供应,从事本公司及代理区内中外企业进出口加工、仓储运输业务,投资咨询服务和其他委托代办业务,投资兴建并经营为区内配套服务设施(涉及许可经营的凭许可证经营)。

三、交易的主要内容

1、交易标的基本情况

物流开发公司于2003年9月23日成立,注册资金人民币15,000万元,原股东分别为三联发公司(出资8,000万元,持股53.33%)、外高桥集团(出资5,500万元,持股36.67%)、上海高东投资经营管理中心(出资1,500万元,持股10%)。

物流开发公司主要经营土地代开发,即代浦东新区土地储备中心开展土地的前期开发,所发生的经营成本包括地上建筑物动拆迁、土地七通一平、管理费用、资金占用成本等,储备中心在土地收储出让后,以部分土地出让金支付给物流开发公司作为收入。

经具有执行证券、期货业务资格的瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)出具的审计报告,并经具有执行证券、期货业务资格的上海申威资产评估有限公司采用资产基础法对委估资产价值评估出具的《资产评估报告》,截至2013年6月30日,物流开发公司的审计、评估结果如下:

单位:元

项 目	账面值	评估值	增 值	增值率
资产总额	523,562,442.42	523,924,749.66	362,307.24	0.07%
负债总额	376,595,120.58	376,595,120.58	—	—
净资产	146,967,321.84	147,329,629.08	362,307.24	0.25%

备注:

2、交易定价

本次收购资产以经评估的净资产值为定价依据,通过参与公开摘牌方式最终确定成交价格。

3、付款约定

(1)三联发公司已支付至上海联合产权交易所的保证金计人民币16,207,622元,在交易合同生效后直接转为产权交易部分价款;

(2)除保证金外,三联发公司应在交易合同签订之日起5个工作日内,将剩余交易价款37,817,786.29元一次性付至上海联合产权交易所指定银行账户。上海联合产权交易所在出具产权交易凭证后,将交易价款划至甲方指定银行账户。

四、本次交易的目的和对公司的影响

本次股权收购有利于消除公司与外高桥集团及其关联方之间潜在的同业竞争,交易价格合理,符合公司的长远发展战略和全体股东的利益,未损害公司及股东权益。

本次收购前,三联发公司持有物流开发公司53.33%的股权,公司已将物流开发公司纳入合并报表范围,因此本次收购不会对上市公司的财务状况和盈利能力形成重大影响。

五、备查文件

《上海市产权交易合同》

《上海外高桥物流开发有限公司审计报告》(瑞华沪专审字【2013】第305C0036号)

《上海外高桥保税区开发股份有限公司拟股权收购涉及的上海外高桥物流开发有限公司股东全部权益评估报告》(沪申威评报字【2013】第0367号)

特此公告。

上海外高桥保税区开发股份有限公司
2014年1月14日

证券代码:600648,900912　　证券简称:外高桥,外高B股　　编号:临2014 -002

上海外高桥保税区开发股份有限公司第七届董事会第二十五次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

上海外高桥保税区开发股份有限公司第七届董事会第二十五次会议于2014年1月11日以现场表决方式召开,应参加会议表决董事9名,实际参加表决董事9名(其中李云章董事委托施伟民董事代为表决)。公司监事和高级管理人员列席会议。会议由董事长舒榕斌先生主持。本次会议的通知、召开、表决程序符合法律法规、规范性文件及《公司章程》规定,所作决议合法有效。

会议经审议全票通过以下决议:

一、审议通过了《关于与招商置业公司合作开发森兰?外高桥商业商务区D1-4、D04-04项目的议案》

鉴于森兰·外高桥商业商务区内D1-4、D04-04项目投资体量较大,为提升项目品质,根据2013年第一次临时股东大会授权,董事会同意公司就D1-4、D04-04项目引进上海招商置业有限公司(以下简称"招商置业公司")作为战略投资者进行合作开发。同意公司与招商置业公司按照4:6的股权比例成立项目公司推进项目开发建设工作,项目公司成立前,双方共同成立项目小组负责项目开发过程中的相关事宜。

招商置业公司成立于2004年,注册资金3000万元,出资方为招商局地产控股股份有限公司(持有招商置业公司10%股权,简称"招商局地产公司")和深圳招商房地产开发有限公司(持有招商置业公司90%股权,是招商局地产公司的全资子公司)。

通过引进招商置业公司合作开发D1-4、D04-04项目,有助于公司缩短项目前期开发周期,减轻项目开发的资金压力,促进合作双方优势互补、利益双赢,加快培育进口商品保税展示交易中心等自由贸易试验区产业功能。

D1-4地块、D04-04地块情况见临时公告(编号:临2013-08)

表决结果为:同意9票,反对0票,弃权0票。

二、审议通过了《关于关于对物流二期6#、7#地块实施前期开发的议案》

同意上海外高桥物流开发有限公司接受浦东新区土地储备中心的委托, 对外高桥物流园区二期中的6#、7#地块进行前期开发(含动迁、土地平整和相关配套建设),6#、7#地块完成前期开发后由浦东新区土地储备中心收储后进行土地招拍挂,土地出让时应充分考虑开发成本、合理定价。

6#、7#地块位于外高桥物流园区二期核心区域,东至港建路,南至规六路,西至华东路,北至申东路。规划面积约50.6万平方米(不含巡关道路和主卡口用地,可挂牌净地面积约为41.33万平方米),规划容积率为0.8-1.2,可打造成集进出口商品展销、仓储、集拼、简单商业加工、分拨配送等业务为一体的第三方综合物流产业区。

表决结果为:同意9票,反对0票,弃权0票。

三、审议通过了《关于购置动迁房源的议案》

同意公司向浦东新区高行镇人民政府或其指定单位购置位于张扬北路西侧、东熙路北侧、浦东北路东侧、德爱路南侧的外高桥新市镇G地块内约80000平方米动迁安置房,购房总价暂定为66400万元(最终结算总价按浦东新区有关政府部门认定的结算单价和实际使用房屋的实测面积计算为准)。

表决结果为:同意9票,反对0票,弃权0票

备查文件:第七届董事会第二十五次会议决议。

特此公告。

上海外高桥保税区开发股份有限公司
二〇一四年一月十四日